

“太平基金-和鑫 1 号集合资产管理计划” 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

资产管理人：太平基金管理有限公司
资产托管人：招商证券股份有限公司
报告送出日期：二〇二三年十月三十日

§ 1 重要提示

资产管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

资产托管人——招商证券股份有限公司根据本资产管理合同规定，于 2023 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，但不保证计划资产一定盈利。过往业绩并不代表其未来表现。资产管理人、资产托管人在资产管理合同中已充分揭示了管理、运用资产管理计划财产进行投资可能面临的风险，资产委托人充分理解相关权利及义务，愿意承担相应的投资风险。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 主要财务指标

单位：人民币元

| 期间数据和指标 | 报告期（2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日） |
|---------|---|
| 本期利润 | -58,945.34 |
| 本期已实现收益 | -182,741.34 |
| 期末数据和指标 | 报告期末（2023 年 09 月 30 日） |
| 期末总资产 | 12,833,519.76 |
| 期末资产净值 | 12,796,485.59 |
| 期末份额净值 | 1.0785 |

注：1、报告截止日 2023 年 09 月 30 日，本资产管理计划份额为 11,865,401.15 份；

2、本期已实现收益指资产管理计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述资产管理计划业绩指标不包括持有人申购或交易资产管理计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§ 3 投资组合报告

3.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占计划总资产的比例 |
|----|----|----|-----------|
|----|----|----|-----------|

| | | (人民币元) | (%) |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | -279,560.00 | -2.18 |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,068,436.91 | 78.45 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,044,642.85 | 23.72 |
| 8 | 合计 | 12,833,519.76 | 100.00 |

3.2 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有股票。

3.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有债券。

3.4 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有资产支持证券。

3.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有权证。

3.6 报告期末资产管理计划投资的期货持仓和损益情况

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|----|----|----------|------|--------|------|
| | | | | | |

| | | | | | |
|--------------|-----------------------|------|--------------|------------|-------------|
| IF2312 | 深 300 股指期 货 2312 | 1.00 | 1,116,480.00 | -28,920.00 | - |
| IH2312 | 上证 50 股指 期货 2312 | 1.00 | 757,320.00 | 10,680.00 | - |
| IH2403 | 上证 50 股指 期货 2403 | 2.00 | 1,529,040.00 | -9,180.00 | - |
| IM2403 | 中证 1000 股 指期货 2403 | 1.00 | 1,205,760.00 | 30,240.00 | - |
| 公允价值变动总额合计 | | | | | 2,820.00 |
| 期货投资本期收益 | | | | | -139,920.00 |
| 期货投资本期公允价值变动 | | | | | 12,600.00 |

§ 4 投资运作情况

4.1 本报告期资产管理计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

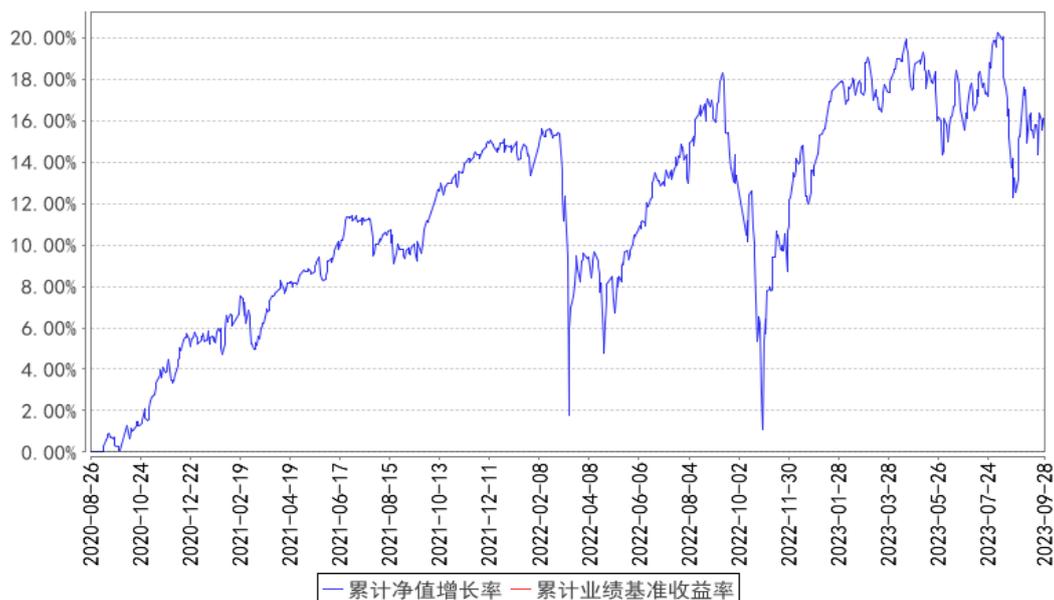
阶段：2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日

| 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|---------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| -0.45% | 0.32% | 0.00% | 0.00% | -0.45% | 0.32% |

注：本资产管理计划无业绩比较基准。

4.2 自资产管理计划运作以来累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本资产管理计划无业绩比较基准。

§ 5 管理人报告

5.1 投资经理简介

李家祺先生，美国佐治亚理工学院理学硕士。具有基金从业资格。7年金融从业经验。曾先后任职国金证券衍生品部、千象资产、招商财富上海事业部，从事量化交易、期权量化投资、衍生品投资等工作。2020年4月加入本公司，自2020年8月26日起担任本资产管理计划投资经理。

5.2 报告期内资产管理计划的投资策略和业绩表现的说明

5.2.1 投资策略和运作分析

本报告期内，产品份额净值增长率为-0.45%。

2023年三季度期权标的指数中，上证50表现最好上涨0.6%，沪深300、中证500、科创50均有不同程度下跌；波动率来看，各指数实际波动率有所回升，均在十一假期前达到短期高点。期权策略在波动率回升过程中加仓了双卖仓位，布局之后的波动率回落，期限结构和曲面斜率方面都布局了各大指数在4季度的回升。

5.2.2 业绩表现

本报告期内，本资产管理计划的份额净值增长率为-0.45%。

5.3报告期内资产管理计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本资产管理计划管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和资产管理合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用资产管理计划资产，在严格控制投资风险的前提下，为资产管理计划份额持有人谋求最大利益，不存在损害资产管理计划份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行资产管理合同的情形。

5.4报告期内公平交易情况的专项说明

5.4.1公平交易制度的执行情况

本资产管理计划管理人设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了专门的公平交易制度，从研究、投资、交易、稽核等环节，对证券投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。同时，通过制定研究、交易等相关制度，建立健全投资对象备选库和交易对手备选库，在确保投资组合间的信息隔离与保密的前提下，建立健全公平的投资管理环境。

报告期内，本资产管理计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《太平基金管理有限公司公平交易管理办法》和《太平基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》等相关规定。

5.4.2异常交易行为的专项说明

公司对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，以防范和控制异常交易。公司经过事前预防、事中监控以及事后排查，在报告期内未发现本资产管理计划存在异常交易行为。

5.4.3本投资组合与证券投资基金之间的业绩比较

本报告期内，公司旗下管理的所有投资组合和证券投资基金严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面确保公平对待不同投资组合和证券投资基金。同时，公司针对不同投资组合和证券投资基

金的整体收益率差异以及分资产类别的收益率差异进行了分析，未发现重大异常情况。

5.5 报告期内关联交易情况说明

本资产管理计划本报告期内未发生关联交易。

5.6 报告期内投资收益分配情况

本资产管理计划本报告期内未进行收益分配。

§ 6 托管人报告

报告期内，本托管人严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规、本计划合同的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、本计划合同的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期《太平基金-和鑫 1 号集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

太平基金管理有限公司

二〇二三年十月三十日